

方正 FIX 统一金融接入平台

接口规范

公司名称	方正证券股份有限公司	文档编号	
文档名称	FIX 网关接入说明	文档版本	1.0
起 草		起草日期	2014 年 2 月 14 日
审 批		审批日期	

修订历史

版本号	日期	状态	修订人	摘要
1.0	2014 年 2 月 17 日	C	郭光煜, 张昊天	增加了使用 Demo 的附录
1.1	2014 年 8 月 7 日	A	郭光煜	增加银证转账, 资金调拨加密, 行情接口

状态标识: C – Created A - Added M - Modified D - Deleted

说明: 该文档所说明的 FIX Demo 是在 Linux Ubuntu 12.04 版本运行的 Eclipse IDE for C/C++ developer 环境下运行测试.

目录

第一章.	FIX 网关介绍.....	6
第二章.	FIX 网关接口说明.....	7
2.1	FIX 版本.....	7
2.2	连接模式.....	7
2.3	会话控制.....	7
2.4	帐户模式.....	7
第三章.	消息格式说明.....	8
3.1	会话层消息.....	8
3.1.1.	登录请求(A).....	8
3.1.2.	登录应答(A).....	10
3.1.3.	注销请求(5).....	11
3.1.4.	注销应答(5).....	12
3.1.5.	心跳包请求(0).....	12
3.1.6.	心跳包应答(0).....	12
3.1.7.	会话拒绝(3).....	13
3.1.8.	重发请求(2).....	13
3.1.9.	序号重置(4).....	14
3.1.10.	心跳测试(1).....	14
3.2	应用层消息.....	15
3.2.1.	交易类消息.....	15
3.2.1.1	单笔委托(D).....	15
3.2.1.2	委托确认, New(8).....	19
3.2.1.3	委托拒绝, Reject(8).....	20

3.2.1.4	执行回报(8).....	21
3.2.1.5	撤单请求(F).....	22
3.2.1.6	撤单确认, PendingCancel(8).....	23
3.2.1.7	撤单拒绝(9).....	24
3.2.1.8	撤单回报, Cancel(8).....	25
3.2.1.9	委托状态查询请求(H).....	26
3.2.1.10	委托状态查询应答 (8).....	27
3.2.1.11	组合委托(COD).....	29
3.2.1.12	组合委托确认, New(8).....	32
3.2.1.13	组合委托拒绝, Reject(8).....	34
3.2.1.14	组合执行回报(8).....	35
3.2.1.15	组合撤单请求(COF).....	36
3.2.1.16	组合撤单确认, PendingCancel(8).....	37
3.2.1.17	组合撤单拒绝(9).....	39
3.2.1.18	组合撤单回报, Cancel(8).....	40
3.2.1.19	组合委托查询请求(COH).....	41
3.2.1.20	组合委托查询应答 (8).....	42
3.2.1.21	批量委托(POD).....	43
3.2.1.22	批量委托确认, New(8).....	45
3.2.1.23	批量委托拒绝, Reject(8).....	46
3.2.1.24	批量执行回报(8).....	47
3.2.2	头寸查询类消息.....	49
3.2.2.1	资金股份查询(UAN).....	49
3.2.2.2	资金股份查询回报(UAP).....	49
3.2.2.3	资金流水查询请求(UAN).....	52

3.2.2.4	资金流水查询应答(UAP).....	52
3.2.2.5	银证转账查询请求(UAN).....	55
3.2.2.6	银证转账查询应答(UAP).....	56
3.2.3	头寸变更类消息.....	58
3.2.3.1	银证转账/银行余额业务流程说明.....	58
3.2.2.7	银证转账/银行余额请求(UAL).....	58
3.2.3.2	银证转账/银行余额应答(UAM).....	60
3.2.3.3	资金调拨请求(UAL).....	61
3.2.3.4	资金调拨应答(UAM).....	62
3.2.3.5	股份调拨请求(UAL).....	63
3.2.3.6	股份调拨应答(UAM).....	64
	附录：测试 Demo 使用说明.....	66

第一章. **FIX** 网关介绍

方正证券的 **FIX** 网关主要是为其交易系统提供 **FIX** 协议接入。实现国际标准协议 **FIX** 与方正证券交易系统的对接。

- **FIX** 网关的功能定义:

实现 **FIX** 协议和证券集中交易系统内部协议（或第三方协议）的转换，转发服务请求和发送成交回报。在集中交易系统与其它交易系统之间通过 **FIX** 协议进行互通连接。提供了如下功能：

- 提供 **FIX** 连接服务
 - ◆ 管理 **FIX** 连接与会话
 - ◆ 接收和发送 **FIX** 协议报文
- 报文转换
 - ◆ 将 **FIX** 协议报文转换成柜台接口报文
 - ◆ 其它协议到 **FIX** 协议
- 业务处理
 - ◆ 管理业务转换流程
 - ◆ 调用柜台接口，执行业务请求，返回执行报告
 - ◆ 成交回报推送

有关 **FIX** 的详细介绍可以在官方网站上找到：<http://www.fixprotocol.org/>

有关 **FIX** 报文的详细介绍可以在下面的站点中查询：

<http://btobits.com/fixopaedia/fixdic42/index.html>

第二章. FIX 网关接口说明

2.1 FIX 版本

方正证券 FIX 网关是在 FIX4.2 基础协议上，扩展了部分 tag 和 MsgType。交易类消息完全符合 FIX4.2 标准，头寸管理变更查询以及担保品划转业务参考了 FIX5.0 的接口定义。

用户数据字典文件为 FIX4.2.XML。

2.2 连接模式

标准模式以网关为 Acceptor，客户端为 Initiator 做为常用模式。

也支持客户为 Acceptor，服务端为 Initiator 模式，此模式与标准模式的区别仅限于连接由谁发起，其它会话控制、消息请求应答同标准模式。

2.3 会话控制

- a. 会话序号 SeqNum 以网关为唯一标准，对端如果收到如“MsgSeqNum too low, expecting 92 but received 22”，这样的提示，需要主动设置会话序号为网关期待值，以便进行正常通讯。
- b. 在交易时间以及非交易时间,允许多次重置序号。
- c. 会话序号应允许手动修改，以便在异常情况时，能双方协商重置到一个安全数值。
- d. 网关支持 7x24 小时连续工作。但在每天交易时间过后，网关会自动进行复位，并发送 Logout 消息，消息体内的 TEXT tag 会被设置为“GWRESET”，表示网关主动复位。对端在收到此消息以后，需要重新发起登录 logon，并把 141(ResetSeqNumFlag)=Y 或者把 MsgSeqNum 设为 1，双方重置会话序号。此时网关系统会清除掉之前保存的临时缓存数据，对端的 ClOrdID 可以复位为 1. 另外网关也支持第二个交易日后自动重置序号模式，即双方在新的交易日自动将序号重置为 1，而不需发送重置序号消息。
- e. 目前仅支持单 Session 单帐户模式，登录必须送入帐户和密码校验通过以后，才允许进行后续业务。
- f. 为了避免重复委托，网关在交易时间，拒绝重发委托消息。

2.4 帐户模式

目前仅支持单 Session 单帐户模式，登录必须送入帐户和密码校验通过以后，才允许进行后续业务。如果同一个帐户在多个不同 Session 上登录，也可以正常下单和返回成交回报，但异常成交回报(NOE)消息只会从第一次登录的 Session 上返回。

异常成交回报(NOE)消息通常是由另一个系统发起的委托产生成交，但成交信息被网关接受，本地无对应的合同序号时产生，网关会发送 ExecReport(8)，但 ClOrdID 不送，表示异常成交回报。

第三章. 消息格式说明

3.1 会话层消息

3.1.1. 登录请求(A)

登录消息是在 FIX 会话开始时，连接双方发送的第一个消息。登录消息总是成对出现，接收方在接收登录消息时，将验证发起方身份的合法性，并且同样发出登录消息给发送方以确认连接请求已被接受。

登录时不强制使用资金账户类别，既可以使用普通资金账户登录，也可以使用信用资金账户登录(如果有的话)。对于同一个客户号下既有普通资金账户，也有信用资金账户的情况，用任何一个资金账户登陆后，可以同时进行普通交易业务和信用交易业务。登陆所采用的资金账户将会作为默认值保存在网关的会话中，如果之后的业务报文中未送资金账户，网关将使用默认值。

登录消息支持两种模式：

(1).Custom 用户登录模式:

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = A
98	EncryptMethod	密码字段加密方式	Y	指明 RawData 字段中,密码字段加密方式。加密后的二进制密文必须按 16 进制序列化可传输文本。支持以下几种方式： '0':不加密 '2':DES-ECB '101':BlowFish 缺省公钥为:" foundersc "
108	HeartBtInt	心跳时间	Y	心跳间隔 在消息交换的空闲期间，连接双方传输有规则的心跳消息，以监控通讯连接的状态。心跳间隔时间 HeartBtInt 由会话发起人在登录时向登录接受方发出，并得到确认。连接双方使用相同的心跳间隔时间。在发送任何消息后，FIX 引擎将心跳间隔计时器清零。

96	RawData	用户密码参数	Y	格式为“帐号类型:帐号:密码:” 帐号类型目前仅支持‘Z’表示使用资金帐号登录。密码字段可以通过在 EncryptMethod 上指明加密方式加密。 例” Z:100012345678:888888:”
95	RawDataLength	数据区长度	C	如果不送, 使用 strlen 得到 RawData 字段长度
141	ResetSeqNumFlag	序号重置标记	N	Y 表示序号重置 N 表示序号不重置 仅当天第一次登录允许重置或者收到网关发来的 Logout 带 Text=“GWRESET”以后, 才允许置上此标志, 否则会被拒绝掉。
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<<SOH>>)

8=FIX.4.2 9=110 35=A 34=6 49=CLIENT02 52=20110812-10:42:52.097 56=SERVER
96=Z:1000000000001:ec9f2461774c39b5: 98=2 108=5 141=N 10=073

(2). username_password 用户登录模式:

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = A
98	EncryptMethod	密码字段加密方式	Y	指明 RawData 字段中, 密码字段加密方式。加密后的二进制密文必须按 16 进制序列化可传输文本。支持以下几种方式: ‘0’: 不加密 ‘2’: DES-ECB ‘101’: BlowFish

				缺省公钥为:" foundersc "
108	HeartBtInt	心跳时间	Y	心跳间隔 在消息交换的空闲期间, 连接双方传输有规则的心跳消息, 以监控通讯连接的状态。心跳间隔时间 HeartBtInt 由会话发起人在登录时向登录接受方发出, 并得到确认。连接双方使用相同的心跳间隔时间。在发送任何消息后, FIX 引擎将心跳间隔计时器清零。
553	Username	用户名	Y	
554	Password	用户密码	Y	密码字段可以通过在 EncryptMethod 上指明加密方式加密。
95	RawDataLength	数据区长度	C	如果不送, 使用 strlen 得到 RawData 字段长度
141	ResetSeqNumFlag	序号重置标记	N	Y 表示序号重置 N 表示序号不重置 仅当天第一次登录允许重置或者收到网关发来的 Logout 带 Text="GWRESET" 以后, 才允许置上此标志, 否则会被拒绝掉。
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	
报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)				
8=FIX.4.2 9=113 35=A 34=14 49=CLIENT02 52=20110812-05:52:53.332 56=SERVER 98=2 108=5 141=N 553=1000000000001 554=ec9f2461774c39b5 10=123				

3.1.2. 登录应答 (A)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
-----	------	------	----	----

	<标准消息头>		Y	MsgType = A
98	EncryptMethod	加密方式	Y	固定为'0'，表示不加密
108	HeartBtInt	心跳时间	Y	
95	RawDataLength	数据区长度	C	如果不送，使用 strlen 得到 RawData 字段长度
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:登陆成功 (注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=72 35=A 34=1 49=SFIXSERVER 52=20140211-05:16:24 56=wudan 98=0 108=30
141=Y 10=137

报文范例:密码错误登陆失败 (注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=156 35=5 34=1 49=SERVER 52=20110803-06:49:12.250 56=CLIENT01 58=Rejected Logon Attempt: error_business: Broker return: Code:-410301080 Msg:-410301080 客户密码错 10=002

3.1.3. 注销请求(5)

注销消息是发起或确认 FIX 会话终止的消息。未经注销消息交换而断开连接，一律视为非正常的断开。

在最后终止会话之前，注销的发起人应该等待连接对方发送确认的注销消息。这使得连接对方有机会进行有必要的缺口填补。如果连接对方没有在适当的时间间隔里作回应，那么会话也可以强行终止。

注销发起人在发送注销消息之后不应发送任何消息，除非接收到连接对方发出的重发请求消息。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 5
58	Text	注销原因	C	如果是网关主动复位，会在此字段填入“GWRESET”
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=58 35=5 34=13 49=CLIENT02 52=20110812-05:52:52.330 56=SERVER 10=255

3.1.4. 注销应答[5]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 5
58	<u>Text</u>	注销原因	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=58 35=5 34=13 49=SERVER 52=20110812-05:52:52.331 56=CLIENT02 10=255

3.1.5. 心跳包请求[0]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 0
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4. 29=72 35=A 34=1 49=SFIXSERVER 52=20140211-05:16:24 56=wudan 98=0 108=30
141=Y 10=137

3.1.6. 心跳包应答[0]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 0
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=54 35=0 34=3 49=SFIXSERVER 52=20140211-05:58:37 56=wudan 10=062

3.1.7. 会话拒绝[3]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =3
45	RefSeqNum	被拒消息序号	Y	
371	RefTagID	参考字段	Y	
372	RefMsgType	参考的消息类型	Y	
373	SessionRejectReason	拒绝原因类型	Y	
58	Text	拒绝原因说明	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=114 35=3 34=3 49=CLIENT02 52=20110826-06:22:26.400 56=SERVER 45=2 58=Tag specified without a value 371=37 372=8 373=4 10=185

3.1.8. 重发请求[2]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 2
7	BeginSeqNo	开始序号	Y	
16	EndSeqNo	结束序号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=69 35=2 34=140 49=CLIENT04 52=20110920-10:26:10.457 56=SERVER 7=50 16=0 10=225

3.1.9. 序号重置[4]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 4
123	GapFillFlag	序号重置模式	Y	Y: 序号重设-缺口填补 N: 序号重设-重设
36	NewSeqNo	新序号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=101 35=4 34=50 43=Y 49=SERVER 52=20110920-10:25:45.812 56=CLIENT04
122=20110920-10:25:45.812 36=82 123=Y 10=098

3.1.10. 心跳测试[1]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 1
112	TestReqID	测试请求标识符	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=67 35=1 34=71 49=SERVER 52=20110919-07:02:52.171 56=CLIENT04 112=TEST
10=027

3.2 应用层消息

3.2.1. 交易类消息

3.2.1.1 单笔委托(D)

注：本消息可以用来发送普通交易及信用交易的委托请求。而究竟是哪种类型的交易请求取决于 Tag77（OpenClose）是否为空。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = D
11	ClOrdID	请求唯一标识符	Y	用于标识此数据包的数字或字符 需要确保该字段的唯一性
21	HandlInst	报盘模式	Y	1 直通私有 2 直通公开 3 交易所 一般使用直通私有(DMA)
40	OrdType	委托类型	Y	1 市价 2 限价
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
60	TransactTime	数据包产生时间	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
77	OpenClose	开仓平仓	C	不送时表示普通交易， 必送时表示信用交易， O 开仓 P 平仓 (与 Side 字段详细对应关系见下方注释)
44	Price	委托价格	C	如果 40 字段为 2, 限价订单时则必送
15	Currency	币种	C	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币 当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 Symbol ，自动判断，可能出错识别错误。
207	SecurityExchange	市场代码	C	XSHG 沪 XSHE 深

				当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 Symbol ，自动判断，可能出错识别错误
1	Account	资金帐号	C	当需要明确市场时,必须送入此字段,否则按照 SecurityExchange 与 Currency 自动判断,可能出错识别错误
167	SecurityType	交易品种	N	CS 表示普通股票 TIPS 国债 EITS 转股 BUYSELL 回购 ETFMM ETF 买卖 ETFSS ETF 申赎 PLECRK 质押出入库
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

以下是测试环境中，测试示例代码

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=15835=D 34=2 49=wudan 52=20140210-06:57:39.914 56=SFIXSERVER 1=12345678 11=145739913 15=CNY 21=1 38=100 40=2 44=6.5 54=1 55=600177 60=20140210-06:57:39 167=CS 207=XSHG 10=146

补充说明：

1：测试程序中与单笔委托对应的函数是：

上海A股买卖：testNewOrderSingle_SHA；

深圳A股买卖：testNewOrderSingle_SZA；

国债买卖：testNewOrderSingle_TIPS；

转股：testNewOrderSingle_EITS；

正逆回购：testNewOrderSingle_BUYSELL；

ETF基金买卖：testNewOrderSingle ETFMM；

ETF基金申赎：testNewOrderSingle ETFSS；

质押出入库：testNewOrderSingle_PLECRK；

这些函数定义在：DemoApplication_Test.cpp 文档中。

2: 各种交易

市场	测试代码	最低测试量	市价委托	限价委托	说明
上海 A 股	600000	100	支持	支持	
深圳 A 股	000002	100	支持	支持	
国债上海	010107	1000	支持	支持	
国债深圳	101315	1000	支持	支持	
转股	113002	100	支持	支持	
逆回购	204004	1000	不支持	支持	
正回购	204001	1000	不支持	支持	
ETF 买卖	159920	1000	支持	支持	
ETF 申赎	510181	1000000	支持	支持	
质押出入库	090107	10000	支持	支持	对应债券:010107

3: 上海 A 股买卖函数 testNewOrderSingle_SHA Demo 代码示例及各段说明:

```
FIX42::NewOrderSingle newOrderSingle;
```

```
// 创立一个单笔委托的object
```

```
newOrderSingle.set(FIX::ClOrdID(clOrdID));
```

```
//传入11字段
```

```
newOrderSingle.set(FIX::HandlInst('1'));
```

```
//选择直通私有
```

```
newOrderSingle.set(FIX::Symbol("600000"));
```

```
// 600000为股票代码
```

```
newOrderSingle.set(FIX::Side(FIX::Side_BUY));
```

```
//买卖方向, FIX::Side_BUY为买, FIX::Side_SELL为卖, 也可以直接穿1表示买, 2表示卖
```

```
newOrderSingle.set(FIX::TransactTime());
```

```
//系统自动生成数据包产生时间
```

```
newOrderSingle.set(FIX::OrdType(FIX::OrdType_MARKET));
```

```
//委托类型, MARKET为市价委托, LIMIT为限价委托.
```

```
newOrderSingle.set(FIX::OrderQty(100));
```

```
//委托数量, 部分交易类型需要数量比较大, 比如深圳市场申赎需要1000000.
```

```
newOrderSingle.set(FIX::Price(11));
```

```
//委托类型为MARKET时不需要此字段, 委托类型为LIMIT的时候需要此字段, 数字需要在涨跌停范围内.
```

```
newOrderSingle.set(FIX::Currency("CNY"));
```

```
//货币种类, CHY为人民币.
```

```
newOrderSingle.set(FIX::SecurityExchange("XSHG"));
```

```
//市场代码: XSHG为上海市场, XSHE为深圳市场.  
newOrderSingle.set(FIX::SecurityType("CS"));  
//交易品种: CS:普通股票, TIPS:国债, EITS:转股, BUYSELL:回购, ETFMM:ETF买卖, ETFSS:ETF申  
赎, PLECRK:质押出入库。  
newOrderSingle.set(FIX::Account(m_sAccount));  
//资金账号
```

4: 注意事项

A: 发送单笔委托时出现, “Logout, Reason=用户不允许操作交易客户”; “转发错误”.

原因: 服务器初始化中.

B: 质押出入库需要先债券抵押入库, 换取标准券. 出库时需卖掉标准券, 之前抵押的债券将回到账户中.

C: ETF申购和赎回的时候需要账户中有股票。

D: 11字段必须是8位或者8位以内。

3.2.1.2 委托确认，New[8]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
1	Account	资金帐号	Y	账户号
6	AvgPx	平均成交价	Y	网关默认为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	网关默认为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	网关默认为 0
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	A, pending new, 表示已收到委; 0, new, 表示委托已确认
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	暂取不到
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
31	LastPx	本次成交均价	N	网关默认为 0
32	LastShares	本次成交数量	N	网关默认为 0
21002	ContractSno	合约编号 String	N	

	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	
报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)				
8=FIX.4.2 9=154 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140213-08:59:59 56=wudan 6=0 11=170116542 14=0 17=0 20=0 31=0 32=0 37=701087 38=100 39=A 44=6.5 54=1 55=600177 150=A 151=100 10=032 ExecutionReport (ClOrdID: 170116542) [PENDING_NEW] 8=FIX.4.2 9=169 35=8 34=3 49=SFIXSERVE R52=20140210-06:56:32 56=wudan 1=12345678 6=0 11=145739913 14=0 17=0 20=0 31=0 32=0 37=700011 38=100.000 39=0 44=7.300 54=1 55=600177 150=0 151=0 10=196 ExecutionReport (ClOrdID: 145739913) [NEW]				

补充说明:

- 1: 上例中的 “ExecutionReport (ClOrdID: 170116542) [PENDING_NEW]” 与 “ExecutionReport (ClOrdID: 145739913) [NEW]” 并非从服务器返回的, 而是我们自己收到消息后利用 OnMessage 回调函数对返回消息进行标注以便于快速阅读这些信息, 在以后的报文范例中我们就不再提示这些信息。
- 2: 回文中 39 字段等于 A 表示该委托已经成功发送给服务器但未跟交易所确认, 39 等于 0 表示成功委托给交易所。

3.2.1.3 委托拒绝, Reject(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
6	AvgPx	平均成交价	Y	网关默认为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	网关默认为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	8,表示委托拒绝

44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	暂取不到
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
31	LastPx	本次成交均价	N	网关默认为 0
32	LastShares	本次成交数量	N	网关默认为 0
58	Text	备注	N	拒绝原因
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=209 35=8 34=2 49=FIXSERVER 52=20140211-03:03:53 56=wudan 6=0
11=110503783 14=0 17=0 20=0 31=0 32=0 37=0 38=100 39=8 44=1.0 54=1 55=699999
58=StkCode 记录不存在(p_stock_code=699999,p_exchange_type=1) 150=8 151=100 10=174

3.2.1.4 执行回报[8]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
1	Account	资金帐号	Y	账户号
6	AvgPx	平均成交价	Y	网关默认为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	网关默认为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	

38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	1 为部分成交,2 为全部成交,6 为待撤,8 为废单
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	1 为部分成交,2 为全部成交
151	LeavesQty	未成交股数	Y	暂取不到
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托所对应的 ClOrdID 当收到未知成交回报时, 此 tag 可不送
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=184 35=8 34=4 49=FIXSERVER 52=20140210-09:12:33 56=wudan 1=12345678 6=0
11=171340727 14=0 17=121794 20=0 31=1.000 32=100.000 37=700037 38=100.000 39=2 44=7.300
54=1 55=600177 150=2 151=0 10=166

3.2.1.5 撤单请求 (F)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = F
11	ClOrdID	请求唯一标识符	Y	用于标识此数据包的数字或字符 需要确保该字段的唯一性
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	撤单数量	Y	协议必送字段,但网关不处理, 只 需确保数据类型为整型即可。

41	OrigClOrdID	被撤包请求唯一标识符	Y	用于标识被撤委托唯一标识符
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
60	TransactTime	数据包产生时间	Y	
167	SecurityType	交易品种	N	CS 表示普通股票
1	Account	资金帐号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

```
8=FIX.4.2 9=155 35=F 34=2 49=wudan 52=20140211-09:15:11.550 56=SFIXSERVER
1=12345678 11=171511550 37=700117 38=100 41=171318306 54=1 55=600177
60=20140211-09:15:11 67=CS 10=106
```

补充说明:

- 1: 测试程序中与撤单请求对应的函数是: `testOrderCancelRequest`
- 2: 由于我们的模拟器在自动成交时总是会成交订单（即使提交的买入价低于市价），所以如果要测试这部分功能，需要将模拟器调成手动成交，这样订单状态处于已报状态，客户可以测试撤单。测试这部分功能时，客户可以联系我们金融工程部。
- 3: 37, 41 字段要从我们下单的应答中读取。测试时我们要读取应答中的这两个字段把它们输入到文档 `DemoApplication_Test.cpp` 中 `testOrderCancelRequest` 函数的相应变量里。

3.2.1.6 撤单确认，**PendingCancel(8)**

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	网关默认为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	网关默认为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	网关默认为 0
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0

37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	6, 待撤
41	OrigClOrdID	源委托请求符	Y	
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side0	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	暂取不到
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	表示撤销委托中对于的 ClOrdID 字段
41	OrigClOrdID	原始订单 clordid	Y	表示撤单的那笔委托
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=153 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140211-09:14:01 56=wudan 6=0 11=171511550 14=0 17=0 20=0 37=700119 38=100 39=6 41=171318306 44=0 54=1 55=600177 150=6 151=0 10=238

3.2.1.7 撤单拒绝[9]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = 9
11	ClOrdID	撤单请求符	Y	表示撤销委托中对于的 ClOrdID 字段

37	OrderID	合同序号	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	订单状态不一定是拒绝(8)，该订单可能全部成交(2)不能再撤单
41	OrigClOrdID	被撤包请求标识符	Y	
102	CancelRejReason	拒绝原因类型	Y	
434	CxlRejResponseTo	拒绝类型	Y	
58	Text	说明	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=173 35=9 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140211-06:14:135 6=wudan 11=141524446
37=0 39=8 41=141327170 58=已报此类市价委托不允许撤单
(p_entrust_prop=U,p_old_entrust_status=8) 102=14 34=1 10=183

3.2.1.8 撤单回报，Cancel(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	网关默认为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	网关默认为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	网关默认为 0
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	4,表示已撤销
41	OrigClOrdID	原委托请求符	Y	
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送

54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	暂取不到
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	N	标识委托所对应的 ClOrdID 当收到未知成交回报时，此 tag 可不送
41	OrigClOrdID	原始订单 clordid	Y	表示撤单的那笔委托
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	
报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)				
8=FIX.4.2 9=193 35=8 34=4 49=SFIXSERVER 52=20140211-09:14:305 6=wudan 1=12345678 6=0 11=171318306 14=0 17=0 20=0 31=6.500 32=-100.000 37=700117 38=100.000 39=4 41=171318306 44=6.500 54=1 55=600177 150=4 151=0 10=072				

3.2.1.9 委托状态查询请求(H)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = H
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	表示要查询的委托请求标志符
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
167	SecurityType	交易品种	N	CS 表示普通股票
37	OrderID	应答唯一标识符	N	

1	Account	资金帐号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	
报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)				
8=FIX.4.2 9=114 35=H 34=2 49=wudan 52=20140211-09:18:16.590 56=SFIXSERVER 1=12345678 11=171816589 37=700117 54=1 55=600177 167=CS 10=219				

补充说明:

- 1: 测试程序中与委托状态查询对应的函数是: testOrderStatusRequest
- 2: 37 字段要从我们下单的应答中读取。测试时我们要读取应答中的这个字段把它们输入到文档 DemoApplication_Test.cpp 中 testOrderStatusRequest 函数的相应变量里。

3.2.1.10 委托状态查询应答 [8]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	
14	CumQty	累计成交数量	Y	
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 3
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	取数据库中记录的字段值
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段

151	LeavesQty	未成交股数	Y	
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

委托成功但未成交:

8=FIX.4.2 9=149 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140211-09:32:29 56=wudan 6=0
11=173311457 14=0 17=0 20=3 37=700125 38=100.00 39=0 44=6.500 54=1 55=600177 150=0
151=100 10=062

ExecutionReport (ClOrdID: 173311457) [NEW]

委托成交成功:

8=FIX.4.2 9=156 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140211-09:30:51 56=wudan 6=6.500
11=173053189 14=100.00 17=0 20=3 37=700123 38=100.00 39=2 44=6.500 54=1 55=600177
150=2 151=0 10=147

ExecutionReport (ClOrdID=173053189) [FILLED]

撤单成功:

8=FIX.4.2 9=149 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140211-09:17:06 56=wudan 6=0
11=171318306 14=0 17=0 20=3 37=700117 38=100.00 39=4 44=6.500 54=1 55=600177 150=4
151=100 10=067

ExecutionReport (ClOrdID: 171318306) [CANCELED]

3.2.1.11 组合委托(COD)

注：本消息可以用来发送组合（篮子）委托交易的委托请求。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = COD
11	ClOrdID	请求唯一标识符	Y	用于标识此数据包的数字或字符 需要确保该字段的唯一性
21	HandlInst	报盘模式	Y	1 直通私有 2 直通公开 3 交易所 一般使用直通私有(DMA)
40	OrdType	委托类型	Y	1 市价 2 限价 仅支持限价委托
22126	SideStr	买卖方向串	Y	买卖方向串（ EntrustNum 位长度买卖串） 最大长度为 500 字节 1 买入 2 卖出 组合的形式如下： 12112 买卖买买
22127	SymbolStr	证券代码串	Y	证券代码串（以' '分隔且需要以' ' 结尾。证券代码个数应与 EntrustNum 一致） 最大长度为 4000 字节 如： 600570 600570
22128	OrderQtyStr	委托数量	Y	委托数量串（以' '分隔且需要以' ' 结尾。委托数量个数应与 EntrustNum 一致） 最大长度为 8000 字节 如：

				100 200
22129	PriceStr	委托价格串	Y	委托价格串(以' '分隔且需要以' '结尾。委托价格个数应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节 如: 100.00 200.00
22130	SecurityExchangeStr	市场代码串	Y	市场代码串(以' '分隔且需要以' '结尾。市场代码个数应与 EntrustNum 一致),最大长度为 2500 字节 XSHG 沪 XSHE 深 如: XSHG XSHE
22145	CurrencyStr	币种串	Y	币种串 (以' '分隔且需要以' '结尾。币种个数应与 EntrustNum 一致),最大长度为 2500 字节 CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币 如: CNY CNY USD
1	Account	资金帐号	Y	
22146	SecurityTypeStr	交易品种串	Y	交易品种串(以' '分隔且需要以' '结尾。交易品种个数应与 EntrustNum 一致),最大长度为 4000 字节 CS 表示普通股票

				TIPS 国债 EITS 转股 BUYSELL 回购 ETFMM ETF 买卖 ETFSS ETF 申赎 如： CS CS ETFSS
22131	AccountStr	证券帐号串	Y	证券帐号串(以' '分隔且需要以' '结尾。证券账号个数应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节 如： 2001287 2001288 2001288
22132	EntrustNum	委托数量	Y	委托笔数(1-500)
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

```
8=FIX.4.2 9=231 35=COD 34=2 49=LIU 52=20140214-09:37:26.201 56=SFIXSERVER
1=22001861 11=173726200 21=1 40=2 22126=11 22127=600000|600018| 22128=200|2000|
22129=9|5| 22130=XSHG|XSHG| 22131=A207950012|A207950012| 22132=2 22145=CNY|CNY|
22146=CS|CS| 10=192
```

补充说明：组合委托请求在测试程序中函数为：testCollectiveOrder。

3.2.1.12 组合委托确认，New(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
6	AvgPx	平均成交价	Y	只为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	只为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	只为 0
38	OrderQty	委托数量	Y	只为 0
39	OrdStatus	委托状态	Y	只为 0
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
55	Symbol	证券代码	Y	只为 0
44	Price	委托价格	C	只为 0
54	Side	买卖方向	Y	只为 1
22133	SuccessNum	成功笔数	Y	
22134	FailNum	失败笔数	Y	
22135	EntrustResult	委托结果	Y	EntrustNum 位长度委托结果串 例如组合委托数量 5 返回结果为 00102 0 成功 1 失败 2 超时 最大长度为 2000 字节
22136	EntrustErrinfoStr	委托错误信息串	Y	最大长度为 8000 字节
22137	EntrustNoStr	委托编号串	Y	（以' '分隔委托编号（失败委托委托号为 0），以' '结尾。委托个数应与 EntrustNum 一致）

				最大长度为 8000 字节
22138	ReportNoStr	申报编号串	Y	(以' '分隔委托编号(失败委托委托号为 0)，以' '结尾。委托个数应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节
22139	SeatNoStr	席位号	Y	各委托席位号以' '隔开 最大长度为 8000 字节
22140	EntrustTimeStr	委接时间	Y	各委托时间以' '隔开 最大长度为 8000 字节
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
58	Text	备注	N	拒绝原因
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

```
8=FIX.4.2 9=248 35=8 34=2 49=FIXSERVER 52=20140214-09:36:06_56=LIU 6=0
11=173726200 14=0 17=0 20=0 37=0 38=0 39=0 44=0 54=1 55=0 150=0 151=0 22133=2 22134=0
22135=00 22136=|| 22137=702121|702119| 22138=701070|701069| 22139=23348|23348|
22140=173606606|173606605| 10=208
```

补充说明：应答中 6，14，17，37，38，39，20，55，44，54 字段都是为满足 FIX 协议人为加的，柜台未返回这些信息。用户读取信息时应忽略这些字段。

3.2.1.13 组合委托拒绝, Reject(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
6	AvgPx	平均成交价	Y	只为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	只为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识	Y	只为
38	OrderQty	委托数量	Y	只为 0
39	OrdStatus	委托状态	Y	8,表示委托拒绝
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
55	Symbol	证券代码	Y	只为 0
44	Price	委托价格	C	只为 0
54	Side	买卖方向	Y	只为 1
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
58	Text	备注	N	拒绝原因
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=144 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-09:58:55 56=LIU_6=0
11=180014834 14=0 17=0 20=0 37=0 38=0 39=8 44=0 54=1 55=0 58=传入参数错误! 150=8 151=0
10=165

3.2.1.14 组合执行回报(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	只为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	只为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	1 为部分成交,2 为全部成交,6 为待撤,8 为废单
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
1	Account	资金帐号	Y	
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	1 为部分成交,2 为全部成交
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托所对应的 ClOrdID 当收到未知成交回报时, 此 tag 可不送
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=184 35=8 34=3 49=SFIXSERVER 52=20140214-09:36:07 56=LIU 1=22001861 6=0 11=173726200 14=0 17=125134 20=0 31=5.000 32=2000.000 37=702119 38=2000.000 39=2 44=5.000 54=1 55=600018 150=2 151=0 10=189
8=FIX.4.2 9=182 35=8 34=4 49=SFIXSERVER 52=20140214-09:36:07 56=LIU 1=22001861 6=0 11=173726200 14=0 17=125135 20=0 31=9.000 32=200.000 37=702121 38=200.000 39=2 44=9.000 54=1 55=600000 150=2 151=0 10=085

3.2.1.15 组合撤单请求 (COF)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = COF
11	ClOrdID	请求唯一标识符	Y	用于标识此数据包的数字或字符 需要确保该字段的唯一性
22132	EntrustNum	委托数量	Y	委托笔数(1-500)
22137	EntrustNoStr	委托编号串	Y	(以' '分隔委托编号(失败委托 委托号为0),以' '结尾。委托个 数应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节
22130	SecurityExchangeStr	市场代码串	Y	市场代码串(以' '分隔且需要以 ' '结尾。市场代码个数应与 EntrustNum 一致),最大长度为 2500 字节 XSHG 沪 XSHE 深 如: XSHG XSHE
22145	CurrencyStr	币种串	Y	币种串(以' '分隔且需要以' '结 尾。币种个数应与 EntrustNum 一致),最大长度为 2500 字节 CNY 人民币 USD 美元 HKD 港

				币 如： CNY CNY USD
1	Account	资金帐号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=143 35=COF 34=2 49=LIU 52=20140214-10:50:03.673 56=SFIXSERVER
1=22001861 11=185003673 22130=XSHG|XSHG| 22132=2 22137=702133|702131|
22145=CNY|CNY| 10=184

补充说明：组合撤单请求在测试程序中函数为：testCollectiveOrderCancelRequest。

3.2.1.16 组合撤单确认， PendingCancel(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	表示撤销委托中对应的 ClOrdID 字段
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
6	AvgPx	平均成交价	Y	只为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	只为 0
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	只为 0
38	OrderQty	委托数量	Y	只为 0

39	OrdStatus	委托状态	Y	只为 0
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
55	Symbol	证券代码	Y	只为 0
44	Price	委托价格	C	只为 0
54	Side	买卖方向	Y	只为 1
22133	SuccessNum	成功笔数	Y	
22134	FailNum	失败笔数	Y	
22135	EntrustResult	委托结果	Y	EntrustNum 位长度委托结果串 例如组合撤单数量 5 返回结果为 00102 0 成功 1 失败 2 超时 最大长度为 2000 字节
22136	EntrustErrinfoStr	委托错误信息串	Y	最大长度为 8000 字节
22137	EntrustNoStr	委托编号串	Y	（以' '分隔委托编号（失败委托委托号为 0），以' '结尾。委托个数应与 EntrustNum 一致） 最大长度为 8000 字节
22141	EntrustNoOldStr	原委托编号串	Y	原委托委托编号串（以' '分隔委托编号（失败委托委托号为 0），以' '结尾,个数与 EntrustNum 一致） 最大长度为 8000 字节
22138	ReportNoStr	原申报编号串（以' '分隔委托编号（失败委托委托号为 0），以' '结尾。委托个数应与 entrust_num 一致）	Y	（以' '分隔委托编号（失败委托委托号为 0），以' '结尾。委托个数应与 EntrustNum 一致） 最大长度为 8000 字节

22139	SeatNoStr	原委托席位号	Y	各委托席位号以' '隔开 最大长度为 8000 字节
22131	AccountStr	证券帐号串	Y	原证券帐号串(以' '分隔且需要以' '结尾。证券账号个数应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节 如: 2001287 2001288
22143	EntrustStatusStr	委托委托状态		原委托委托状态 (EntrustNum 位长度的委托状态串) 最大长度为 500 字节
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

```
8=FIX.4.2 9=280 35=8 34=2 49=FIXSERVER 52=20140214-10:48:43 56=LIU 6=0 11=185003673
14=0 17=0 20=0 37=0 38=0 39=0 44=0 54=1 55=0 150=0 151=0 22131=A207950012|A207950012|
22133=2 22134=0 22135=00 22136=|| 22137=702135|702137| 22138=701076|701075|
22139=23348|23348| 22141=702133|702131| 22143=00 10=110
```

3.2.1.17 组合撤单拒绝[9]

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=9
11	ClOrdID	撤单请求符	Y	表示撤销委托中对于的 ClOrdID 字段
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	只为 0
39	OrdStatus	委托状态	Y	只为 0

41	OrigClOrdID	被撤包请求标识符	Y	只为 0
102	CancelRejReason	拒绝原因类型	Y	
434	CxlRejResponseTo	拒绝类型	Y	
58	Text	备注	N	拒绝原因
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=110 35=9 34=2 49=FIXSERVER 52=20140214-10:41:23 56=LIU 11=184242969
37=0 39=8 41=0 58=传入参数错误! 102=1 434=1 10=236

3.2.1.18 组合撤单回报，Cancel(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	
14	CumQty	累计成交数量	Y	
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
1	Account	资金账户	Y	
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	4,表示已撤销
41	OrigClOrdID	源委托请求符	Y	
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送

54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	N	标识委托所对应的 ClOrdID 当收到未知成交回报时，此 tag 可不送
41	OrigClOrdID	原始订单 clordid	Y	表示撤单的那笔委托
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=191 35=8 34=7 49=SFIXSERVER 52=20140214-10:51:11 56=LIU_1=22001861 6=0
11=184723395 14=0 17=0 20=0 31=9.000 32=-200.000 37=702133 38=200.000 39=4 41=184723395
44=9.000 54=1 55=600000 150=4 151=0 10=006

8=FIX.4.2 9=193 35=8 34=8 49=SFIXSERVER 52=20140214-10:51:13 56=LIU 1=22001861_6=0
11=184723395 14=0 17=0 20=0 31=5.000 32=-2000.000 37=702131 38=2000.000 39=4
41=184723395 44=5.000 54=1 55=600018 150=4 151=0 10=106

3.2.1.19 组合委托查询请求(COH)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = H
22132	EntrustNum	委托数量	Y	委托笔数(1-500)
22137	EntrustNoStr	委托编号串	Y	(以' '分隔委托编号(失败委托委托号为0)，以' '结尾。委托个数

				应与 EntrustNum 一致) 最大长度为 8000 字节
1	Account	资金帐号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=98 35=COH 34=2 49=LIU 52=20140214-10:33:19.532 56=SFIXSERVER 1=22001861 22132=2 22137=700241 701640 10=124

补充说明：组合委托查询请求在测试程序中函数为：testCollectiveOrderStatusRequest。

3.2.1.20 组合委托查询应答 (8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	
14	CumQty	累计成交数量	Y	
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 3
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	取数据库中记录的字段值
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段

151	LeavesQty	未成交股数	Y	
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=153 35=8 34=2 49=FIXSERVER 52=20140214-10:31:59 56=LIU 6=3.000
11=700241 14=8400.00 17=0 20=3 37=700241 38=8400.00 39=2 44=3.000 54=1 55=601668 150=2
151=0 10=037

3.2.1.21 批量委托 (POD)

注：本消息可以用来发送批量普通交易委托请求。此接口不支持多股东委托。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = POD
11	ClOrdID	请求唯一标识符	Y	用于标识此数据包的数字或字符 需要确保该字段的唯一性
21	HandlInst	报盘模式	Y	1 直通私有 2 直通公开 3 交易所 一般使用直通私有(DMA)
40	OrdType	委托类型	Y	1 市价 2 限价
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
60	TransactTime	数据包产生时间	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
44	Price	委托价格	C	如果 40 字段为 2,限价订单时则

				必送
15	Currency	币种	C	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币 当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 Symbol ，自动判断，可能出错识别错误。
207	SecurityExchange	市场代码	C	XSHG 沪 A XSHE 深 A 当需要明确市场时，必须送入此字段，否则按 Symbol ，自动判断，可能出错识别错误
1	Account	资金帐号	C	当需要明确市场时,必须送入此字段,否则按照 SecurityExchange 与 Currency 自动判断,可能出错识别错误
167	SecurityType	交易品种	N	CS 表示普通股票 TIPS 国债 EITS 转股 BUYSELL 回购 ETFMM ETF 买卖 ETFSS ETF 申赎
22144	EntrustCount	生成委托数	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=166 35=POD 34=2 49=LIU 52=20140217-03:15:11.370 56=SFIXSERVER
1=22001861 11=111511369 15=CNY 21=2 38=200 40=1 54=1 55=600017 60=20140217-03:15:11
167=CS 207=XSHG 22144=2 10=041

补充说明：在测试程序中批量委托请求的函数为：testBatchOrder。

3.2.1.22 批量委托确认，New(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
6	AvgPx	平均成交价	Y	只为 0
14	CumQty	累计成交数量	Y	只为 0
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	内容同 ClOrdID
38	OrderQty	委托数量	Y	委托数量（表示委托成功后返回成功数量）
39	OrdStatus	委托状态	Y	只为 0
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
22144	EntrustCount	生成委托数	Y	生成委托数，委托成功股数
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

```
8=FIX.4.2 9=159 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140217-03:13:42 56=LIU 6=0 11=111511369
14=0 17=0 20=0 37=111511369 38=400.000000000 39=0 44=0_54=1_55=600017 150=0 151=0
22144=2 10=041
```

3.2.1.23 批量委托拒绝, Reject(8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType=8
6	AvgPx	平均成交价	Y	
14	CumQty	累计成交数量	Y	
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	0
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	8,表示委托拒绝
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	同 39 字段
151	LeavesQty	未成交股数	Y	只为 0
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托请求中所对应的 ClOrdID
58	Text	备注	N	拒绝原因
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=212 35=8 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-10:27:02 56=LIU 6=0 11=182822148
14=0 17=0 20=0 37=0 38=200 39=8 44=95 54=1 55=600017 58=超过涨跌停范围
(p_entrust_price=95.000,v_up_price=2.760,v_down_price=2.260) 150=8 151=0 10=229

3.2.1.24 批量执行回报 (8)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =8
6	AvgPx	平均成交价	Y	
14	CumQty	累计成交数量	Y	
17	ExecId	执行结果唯一标识符	Y	
20	ExecTransType	应答发送类别	Y	只为 0
37	OrderID	应答唯一标识符	Y	
38	OrderQty	委托数量	Y	
39	OrdStatus	委托状态	Y	1 为部分成交,2 为全部成交,6 为待撤,8 为废单
44	Price	委托价格	C	当订单是限价委托时必送
54	Side	买卖方向	Y	1 买入 2 卖出
55	Symbol	证券代码	Y	
150	ExecType	执行结果	Y	1 为部分成交,2 为全部成交
151	LeavesQty	未成交股数	Y	
11	ClOrdID	委托请求唯一标识符	Y	标识委托所对应的 ClOrdID 当收到未知成交回报时, 此 tag 可不送
31	LastPx	本次成交均价	N	
32	LastShares	本次成交数量	N	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=182 35=8 34=3 49=SFIXSERVER 52=20140217-03:13:43 56=LIU 1=22001861 6=0
11=111511369 14=0 17=125176 20=0 31=1.000 32=200.000 37=700047 38=200.000 39=2 44=2.770
54=1 55=600017 150=2 151=0 10=093

8=FIX.4.2 9=182 35=8 34=4 49=SFIXSERVER 52=20140217-03:13:44 56=LIU 1=22001861 6=0
11=111511369 14=0 17=125177 20=0 31=1.000 32=200.000 37=700049 38=200.000 39=2 44=2.770
54=1 55=600017 150=2 151=0 10=098

3.2.2 头寸查询类消息

3.2.2.1 资金股份查询(UAN)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAN
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	要求客户端维护其唯一性，以此作为网关端回报的标识符。
724	PosReqType	请求类别	Y	0 查询股份 9 查询资金
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)[资金查询]

8=FIX.4.2 9=97 35=UAN 34=2 49=LIU 52=20140213-05:42:12.291 56=SFIXSERVER 1=99115551
581=300 710=134212290 724=9 10=181

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)[股份查询]

8=FIX.4.2 9=97 35=UAN 34=2 49=LIU 52=20140213-05:18:43.639 56=SFIXSERVER 1=99115551
581=300 710=131843639 724=0 10=199

补充说明：测试程序中资金股份查询查询对应的函数是：testHsRequestForPositions_Stock。

3.2.2.2 资金股份查询回报(UAP)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAP
721	PosMaintRptID	响应消息唯一标识符	Y	用于标识本响应消息唯一标识符

710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
724	PosReqType	请求类别	Y	0 查询股份 9 查询资金
727	TotalNumPosReports	返回报告条数	Y	
728	PosReqResult	报告返回代码	Y	0 成功 其他 失败
912	LastRptRequested	后续结果	Y	N 还有后续报告 Y 本报告为最后一条报告
1	Account	资金账户/股东账户	Y	
581	AccountType	账户类型	Y	当 724=9 时: 300 资金账户 当 724=0 时: 301 股东账户
58	Text	说明	C	只有 728 不为 0 时返回
Group	702 NoPositions		C	重复计组数域
	703 PosType	类型说明	C	当 724=0 时 SB 股份余额 SAV 股份可用余额 SQ 当前持股数 此字段必须为 group item 的第一个字段
	704 LongQty	多仓数量	C	表示多仓数量 (当 703= SB SAV、SQ、时)
	705 ShortQty	空仓数量	N	表示空仓数量

Group	753	<u>NoPosAmt</u>		C	重复计组数域
	707	<u>PosAmtType</u>	金额类型	C	当 724=9 时 FB 资金余额 FAV 资金可用余额 MV 资产总值 F 资金资产 SV 市值 FBF 资金买入冻结 此字段必须为 group item 的第一个字段
	708	<u>PosAmt</u>	金额	C	
15	<u>Currency</u>		币种	N	
55	<u>Symbol</u>		证券代码	N	
207	<u>SecurityExchange</u>		市场代码	N	XSHG 沪 XSHE 深
	<标准消息尾>		接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)[资金查询回报]

8=FIX.4.2 9=202 35=UAP 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140213-05:40:56_56=LIU 1=99115551
 15=CNY 581=300 710=134212290 721=1 724=9 727=1 728=0 753=3 707=FB 708=102900317.01
 707=FAV 708=102896124.78 707=F 708=102896124.78 912=Y 10=023

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)[股份查询回报]

8=FIX.4.2 9=205 35=UAP 34=13 49=SFIXSERVER 52=20140213-05:17:27 56=LIU 1=0100027471
 55=111039 207=XSHE 581=301 702=3 703=SB 704=1000000 703=SAV 704=1000000 703=SQ
 704=1000000 710=131843639 721=12 724=0 727=19 728=0 912=N 10=121

补充说明： 703 字段中 SB 股份余额是系统当天初始化后的值，一天不变。

3.2.2.3 资金流水查询请求(UAN)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAN
710	PosReqID	请求号	Y	用于标识此数据包的数字或字符
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户
724	PosReqType	请求类别	Y	103,表示查询资金流水
916	StartDate	开始时间	N	不送的话,该字段值默认为今日
917	EndDate	结束时间	N	不送的话,该字段值默认为今日
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=99 35=UAN 34=2 49=LIU 52=20140214-03:10:54.192 56=SFIXSERVER 1=22001861 581=300
710=112943110 724=103 10=002

补充说明:

1: 测试程序中与资金流水查询请求对应的函数是: testHsRequestForPositions_MoneyFlow。

2: 这里我们是用极速交易系统做测试, 由于系统每日初始化, 所以只能查当日流水。

3.2.2.4 资金流水查询应答(UAP)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAP
721	PosMaintRptID	响应消息唯一标识符	Y	用于标识本响应消息唯一标

				识符
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
724	PosReqType	请求类别	Y	103,表示查询资金流水
727	TotalNumPosReports	返回报告条数	Y	
912	LastRptRequested	后续结果	Y	N 还有后续报告 Y 本报告为最后一条报告
728	PosReqResult	报告返回代码	Y	0 成功 99 失败
715	ClearingBusinessDate	清算日期	C	格式为本地时间
743	DeliveryDate	交收日期	C	格式为本地时间
15	Currency	币种	C	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
207	SecurityExchange	市场代码	C	XSHG 沪 XSHE 深
37	OrderID	合同序号	C	
14	CumQty	成交数量	C	
6	AvgPx	平均成交价	C	
Group	NoPositions		C	目前柜台无返回，此项为空值。
	703	PosType	类型说明	C 当 724=10 时 SB 股份本次余额
	704	LongQty	数量	C
Group	753	NoPosAmt		C 重复计组数域
	707	PosAmtType	金额类型	C 当 724=10 时 FH 资金发生数

					FB 资金本次余额 TB 成交金额（目前为空）
	708	<u>PosAmt</u>	金额	C	
Group	NoEvents			C	
	865	<u>EventType</u>	业务代码	C	
	868	<u>EventText</u>	业务说明	C	
	1145	<u>EventTime</u>	<u>业务发生时间</u>	C	
Group	UgAccounts			C	自定义 Group
	1	Account	账户	C	
	581	<u>AccountType</u>	账户类型	C	300 资金账户 301 股东账户
55	<u>Symbol</u>	证券代码		C	
54	<u>Side</u>	买卖方向		C	
58	<u>Text</u>	错误原因		N	<u>当 728 不为 0 时返回</u>
	<标准消息尾>			Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=229 35=UAP 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-03:28:24 56=LIU 1=22001861
6=0 14=0 15=CNY 37=35 581=300 710=112943110 721=1 724=103 727=2 728=0 753=3 707=FB
708=1.00 707=FB 708=98773608.76 707=TB 708=0 864=1 865=0 1145=100341 868= 912=N
10=071

8=FIX.4.2 9=229 35=UAP 34=3 49=SFIXSERVER 52=20140214-03:28:24_56=LIU 1=22001861
6=0 14=0 15=CNY 37=36 581=300 710=112943110 721=2 724=103 727=2_728=0_753=3 707=FB
708=1.00 707=FB 708=98773609.76 707=TB 708=0 864=1 865=0 1145=100356 868= 912=Y
10=092

补充说明:

1: 6, 14 字段返回始终为零, 主要为了满足标准, 客户不要用这两个字段

2: 868 字段这里由于柜台无返回, 所以返回的是空格。

3.2.2.5 银证转账查询请求(UAN)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAN
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户
37	OrderID	银证转账/银行余额合同号	Y	
724	PosReqType	请求类别	Y	100 银证转账/银行余额
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=111 35=UAN 34=2_49=LIU 52=20140214-07:52:39.126 56=SFIXSERVER
1=22001861 15=CNY 37=7 581=300 710=155239126 724=100 10=161

补充说明:

1: 测试程序中与银证转账查询请求对应的函数是: testHsRequestForPositions_TransferFlow。

2: 做这个测试我们需要向服务器发送37字段, 所以我们先要做一笔银证转账从服务器返回一个OrderID (37), 然后在我们的函数testHsRequestForPositions_TransferFlow中输入这个OrderID来查询。可以在文档DemoApplication_Test.cpp中直接更改这个函数。

3.2.2.6 银证转账查询应答(UAP)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAP
721	PosMaintRptID	响应消息唯一标识符	Y	用于标识本响应消息唯一标识符
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
724	PosReqType	请求类别	Y	100 银证转账/银行余额
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户 301 股东账户 (若请求消息中存在,则此处会返回,无则不返回)
37	OrderID	银证转账/银行余额合同号	Y	
729	PosReqStatus	业务处理状态	C	当 728=0 时 0 成功 2 拒绝 101 未报 102 已报
728	PosReqResult	报告返回代码	Y	0 成功 99 失败
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
727	TotalNumPosReports	返回报告条数	Y	
782	SettlPartyID	银行代码	Y	银行代码
709	PosTransType	转换方向	Y	100 银行转证券

					101 证券转银行 102 银行余额
Group	<u>NoPosAmt</u>			C	
	707	<u>PosAmtType</u>	金额类型	C	FBB 资金余额 必送 当 709=100 时, FE 银证 转账委托金额 必送
	708	<u>PosAmt</u>	金额	C	表示金额
	<标准消息尾>			Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=165 35=UAP 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-07:51:19 56=LIU 1=22001861
15=CNY 37=7 581=300 709=102 710=155239126 721=1 724=100 727=1 728=0 729=2 753=1
707=FBB 708=0 782=C 10=111

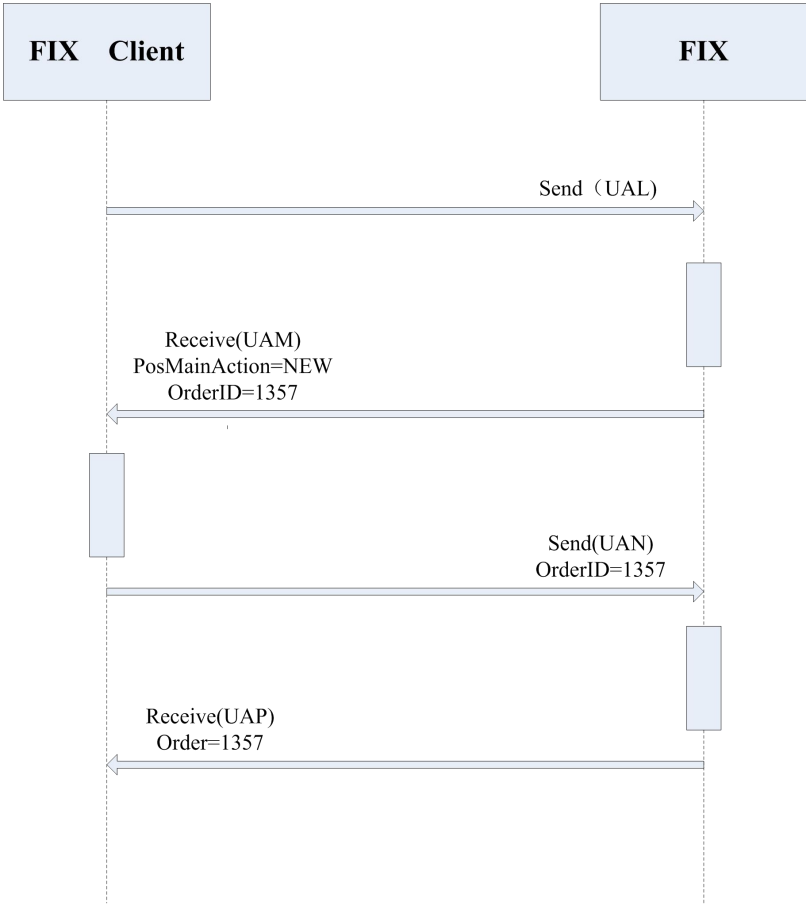
补充说明:

- 1: 708 = 0, 这是由于在测试环境下模拟器没连接银行账户, 统一返回 0。
- 2: 782 = c, 是建行代码 9003 在 06 柜台上的编号。

3.2.3 头寸变更类消息

3.2.3.1 银证转账/银行余额业务流程说明

FIX 客户端通过使用 `MsgType = UAL` 消息发送银证转账/银行余额请求给 FIX 网关,如果请求被接收,FIX 网关会发送 `MsgType = UAM` 的应答消息给 FIX 客户端,其中 `Tag37 OrderID` 为交易系统给出的委托序号,FIX 客户端使用 `MsgType = UAN` 消息发送银证转账/银行余额查询请求给 FIX 网关,其中 `Tag724 PosReqType` 为 100(银证转账)并带上 `Tag37` 标识银证转账/银行余额请求的委托序号,网关发送 `MsgType = UAP` 的 应答消息响应请求,详情请见具体接口字段表以及下图.



3.2.2.7 银证转账/银行余额请求 (UAL)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAL

710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	
709	PosTransType	转换方向/类型	Y	100 银行转证券 101 证券转银行 102 银行余额
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户 301 股东账户 不送则默认为股东代码
98	EncryptMethod	密码字段加密方式	Y	指明 RawData 字段中, 密码字段加密方式。加密后的二进制密文必须按 16 进制序列化可传输文本。支持以下几种方式: '0': 不加密 '2': DES-ECB '101': BlowFish 缺省公钥为: "**证券"
554	Password	银行密码	Y	
21004	FundPassword	资金密码	Y	
782	SettlPartyID	银行代码	Y	
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
753	NoPosAmt	头寸金额	N	当 PosTransType =100 或 101 时必送
→	707	PosAmtType	Y	FE 银证转账委托金额
→	708	PosAmt	Y	金额
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>) 银证转账
8=FIX.4.2 9=155 35=UAL 34=2 49=LIU 52=20140214-06:26:25.326 56=SFIXSERVER 1=22001861 15=CNY 554=1 581=300 709=100 710=142625325 753=1 707=FE 708=10001100 782=9003 21004=1 10=183

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>) 银行余额
8=FIX.4.2 9=129 35=UAL 34=2 49=LIU 52=20140214-06:47:35.063 56=SFIXSERVER 1=22001861 15=CNY 554=1 581=300 709=102 710=144735063 782=9003 21004=1 10=234

补充说明:

- 1: 在测试程序中与银证转账对应的函数是: testPositionMaintenanceRequest_Transfer_B2S。
- 2: 与银行余额请求对应的函数是: testPositionMaintenanceRequest_Balance。
- 3: 在测试程序的 testPositionMaintenanceRequest_Transfer_B2S 函数中, 782 字段 SettlePartyID 我们设为“9003”(为建行代码)。如果用的测试帐号对应的银行不一样, 需要在这个函数中更改一下。

3.2.3.2 银证转账/银行余额应答(UAM)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAM
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
709	PosTransType	转换方向	Y	100 银行转证券 101 证券转银行 102 银行余额
712	PosMaintAction	应答行为	Y	1New 表示被交易系统接受 3cancel 表示拒绝
721	PosMaintRptID	应答唯一标识符	Y	用于标识应答唯一标识符
722	PosMaintStatus	应答状态	Y	当 712=1 时 0 Accepted

				当 712=3 时 2 Rejected
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
1	Account	资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户 301 股东账户 (若请求消息中存在,则此处会返回,无则不返回)
37	OrderID	银证转账合同号	C	当 712=1 时
782	SettlPartyID	银行代码	Y	
58	Text	说明	C	只有 712 为 3 时返回
753	NoPosAmt	头寸金额	N	当 PosTransType =100 或 101 时必送
→	707	PosAmtType	Y	FE 银证转账委托金额
→	708	PosAmt	Y	金额
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>) 银证转账

8=FIX.4.2 9=160 35=UAM 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-06:25:07 56=LIU 1=22001861
15=CNY 37=3 581=300 709=100 710=142625325 712=1 721=1 722=0 753=1 707=FE
708=10001100 782=9003 10=109

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>) 银行余额

8=FIX.4.2 9=134 35=UAM 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-06:46:16 56=LIU 1=22001861
15=CNY 37=5 581=300 709=102 710=144735063 712=1 721=1 722=0 782=9003 10=163

3.2.3.3 资金调拨请求(UAL)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAL
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	
709	PosTransType	转换方向/类型	Y	300 资金柜台转 VIP 301 资金 VIP 转柜台
1	Account	此消息中代表指明的资金账户	Y	
98	EncryptMethod	密码字段加密方式	Y	指明 RawData 字段中,密码字段加密方式。加密后的二进制密文必须按 16 进制序列化可传输文本。支持以下几种方式: '0':不加密 '2':DES-ECB '101':BlowFish 缺省公钥为:" foundersc "
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户
554	Password	银行密码	Y	
21004	FundPassword	资金密码	Y	
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
753	NoPosAmt	头寸金额	Y	当 PosTransType =100 或 101 时必送
→	707	PosAmtType	Y	FT 调拨金额
→	708	PosAmt	Y	金额
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=143 35=UAL 34=2 49=LIU 52=20140214-09:14:39.118 56=SFIXSERVER 1=22001861 15=CNY 554=1 581=301 709=300 710=171439117 753=1 707=FT 708=10001 21004=1 10=146

补充说明：资金调拨在极速交易系统与 06 交易柜台间进行。在测试程序中资金调拨请求函数为：
testPositionMaintenanceRequest_MoneyTransfer_062UFT。

3.2.3.4 资金调拨应答(UAM)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAM
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
709	PosTransType	转换方向	Y	300 柜台转 VIP 301 VIP 转柜台
712	PosMaintAction	应答行为	Y	1New 表示被交易系统接受 3cancel 表示拒绝
721	PosMaintRptID	应答唯一标识符	Y	用于标识应答唯一标识符
722	PosMaintStatus	应答状态	Y	当 712=1 时 0 Accepted 当 712=3 时 2 Rejected
15	Currency	币种	Y	CNY 人民币 USD 美元 HKD 港币
1	Account	资金账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	300 资金账户
58	Text	说明	C	只有 712 为 3 时返回
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=120 35=UAM 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-09:13:19 56=LIU 1=22001861 15=CNY 581=301 709=300 710=171439117 712=1 721=0 722=0 10=023

3.2.3.5 股份调拨请求 (UAL)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAL
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	
709	PosTransType	转换方向/类型	Y	302 股份柜台转 VIP 303 股份 VIP 转柜台
1	Account	股东账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	301 股东账户
207	SecurityExchange	市场代码	C	XSHG 沪 XSHE 深 当需要明确市场时, 必须送入此字段, 否则按 Symbol , 自动判断, 可能出错识别错误
55	Symbol	证券代码	Y	
53	Quantity	过户数量	Y	
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)
8=FIX.4.2 9=127 35=UAL 34=2 49=LIU 52=20140214-09:24:31.223 56=SFIXSERVER 1=A207950012 53=600 55=600000 207=XSHG 581=301 709=303 710=172431222 10=193

补充说明: 股份调拨在极速交易系统与 06 交易柜台间进行。在测试程序中股份调拨请求函数为:
testPositionMaintenanceRequest_ShareTransfer_062UFT。

3.2.3.6 股份调拨应答(UAM)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType = UAM
710	PosReqID	请求唯一标识符	Y	用于标识请求唯一标识符
709	PosTransType	转换方向	Y	300 柜台转 VIP 301 VIP 转柜台
712	PosMaintAction	应答行为	Y	1New 表示被交易系统接受 3cancel 表示拒绝
721	PosMaintRptID	应答唯一标识符	Y	用于标识应答唯一标识符
722	PosMaintStatus	应答状态	Y	当 712=1 时 0 Accepted 当 712=3 时 2 Rejected
1	Account	股东账户	Y	
581	AccountType	账户类型	C	301 股东账户
58	Text	说明	C	只有 712 为 3 时返回
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=115 35=UAM 34=2 49=SFIXSERVER 52=20140214-09:23:11 56=LIU 1=A207950012
581=301 709=303 710=172431222 712=1 721=0 722=0 10=246

3.2.4 行情

3.2.4.1 行情订阅, 取消订阅

此消息实现行情的订阅和取消订阅 (通过 SubscriptionRequestType 指定)

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
-----	------	------	----	----

	<标准消息头>		Y	MsgType =V
262	MDReqID	请求编号	Y	
263	SubscriptionRequestType	请求类型	Y	0 订阅 2 取消订阅
146	NoRelatedSym	证券代码计数	Y	
→	55	Symbol	Y	证券代码
→	207	SecurityExchange	Y	市场类型 XSHG 沪 XSHE 深
	<标准消息尾>		Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=115 35=V 34=2 49=FIXSERVER 52=20140214-09:23:11 56=LIU 146=1 56=600000
207=XSHG 262=12414384 263=0 10=246

补充说明: 行情订阅请求函数为: testMarketDataRequest

3.2.4.2 订阅应答

如果订阅(取消订阅)成功, 返回此消息。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =X
262	MDReqID	请求编号	Y	
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=88 35=X 34=2 49=FIXSERVER 52=20140807-03:24:11.001 56=LIU 262=12414384
268=1 279=0 10=042

3.2.4.3 拒绝订阅

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =Y
262	MDReqID	订阅请求标识	Y	
281	MDReqRejReason	拒绝原因	N	
58	Text	说明	N	
	<标准消息尾>		Y	

3.2.4.5 行情主推

行情信息主要五档（十档）买卖价、买卖量，开盘价，收盘价，最新成交价，最新成交量，最高价，最低价，其中五档（十档）买卖在 NoMDEntries 重复组中。

Tag	字段名称	字段说明	必送	注释
	<标准消息头>		Y	MsgType =W
55	Symbol	证券代码	Y	
31	LastPx	最新价	Y	
32	LastShares	最新成交量	Y	
332	HighPx	最高价	Y	
333	LowPx	最低价	Y	
268	NoMDEntries	行情条目计数	Y	
→	269	MDEntryType	Y	行情类型 0 买入 1 卖出
→	270	MDEntryPx	Y	价格
→	271	MDEntrySize	Y	数量

→	1023	<u>MDPriceLevel</u>	Y	价格档位
	<标准消息尾>	接收者 ID	Y	

报文范例:(注意:两个 Tag 间的空格实际上是不可见字符<SOH>)

8=FIX.4.2 9=810 35=W 34=3 49=FIXSERVER 52=20140807-03:24:12.584 56=gyh85018601
31=9.690 32=54866025 55=600000 268=20 269=0 270=9.690 271=267051 1023=1 269=0 270
=9.680 271=1615698 1023=2 269=0 270=9.670 271=2231132 1023=3 269=0 270=9.660 271
=1557300 1023=4 269=0 270=9.650 271=1781200 1023=5 269=0 270=9.640 271=1471200 1
023=6 269=0 270=9.630 271=361100 1023=7 269=0 270=9.620 271=1408800 1023=8 269=0
270=9.610 271=629500 1023=9 269=0 270=9.600 271=2712700 1023=10 269=1 270=9.700
271=508699 1023=1 269=1 270=9.710 271=324790 1023=2 269=1 270=9.720 271=368472
1023=3 269=1 270=9.730 271=508849 1023=4 269=1 270=9.740 271=595778 1023=5 269=1
270=9.750 271=914389 1023=6 269=1 270=9.760 271=841751 1023=7 269=1 270=9.770 2
71=383934 1023=8 269=1 270=9.780 271=590203 1023=9 269=1 270=9.790 271=59058010
23=10 332=9.780 333=9.670 10=034

附录：测试 Demo 使用说明

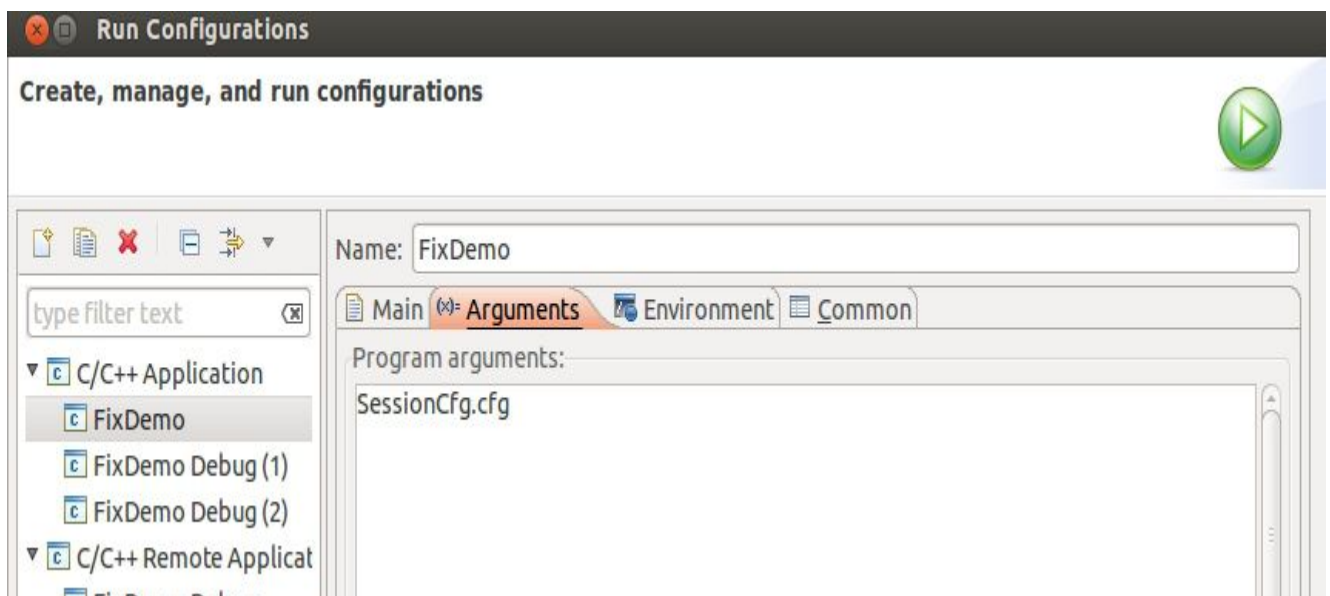
1: 测试 Demo 的安装

我们的测试 Demo 是用 C++写的，在程序中我们使用了 QuickFIX 库。QuickFIX 是一个 C++实现的金融交换协议 FIX 的引擎。用户可以在下面的链接中了解 QuickFIX 的一些信息：

<http://www.quickfixengine.org/>

为了使用我们的测试 Demo，用户需要下载并安装 QuickFIX。在上述网站的 documentation 页面， 用户可以获得非常详细的指引。

2: FixDemo.cpp 文档有我们的主程序，带有参数 argc, argv。在运行程序时我们要传入 QuickFIX 配置文件的文件名：SessionCfg.cfg 作为参数。对于使用 Eclipse 的用户，可以在 Run Configurations 的 Arguments 选项中输入：



在配置文件 SessionCfg.cfg 中，用户可以输入服务器的 IP，Port number，用户名等。例如：

```

[DEFAULT]
ConnectionType=initiator
ReconnectInterval=2
FileStorePath=somewhere
FileLogPath=log
StartTime=01:00:00
EndTime=23:00:00
UseDataDictionary=Y
DataDictionary=FIX42.xml
HttpAcceptPort=9911
SocketConnectPort=5005
SocketConnectHost=192.168.132.47

LogoutTimeout=5
ResetOnLogon=Y

[SESSION]
BeginString=FIX.4.2
HeartBtInt=30
SenderCompID=sq01
TargetCompID=SFIXSERVER
FileStorePath=somewhere
DataDictionary=FIX42.xml

```

3: libufx_security.so 是我们的加密解密库， Demo 中带的是适用于 32 位系统的。如果您使用的是 64 位系统，相应的加密解密库可以在文件夹“加密解密库”下找到。ufx_security_interface.h 是加密解密函数的头文件。

4: 由于我们的协议在 FIX4.2 基础上进行了扩展，增加了 UAN, UAP, UAL, UAM, COD, COF, COH, POD 这些消息。为了发送和接收这些消息，在 Demo 中我们写了与这些消息相应的类，这些构成了我们 Demo 中文件名以 Hs 开头的 8 个头文件。另外两个文件名以 Hs 开头的头文件： HsFixFields.h 用来加入我们新定义的 FIX4.2 中没有的字段，HsFixFieldNumbers.h 用来加入新定义的字段的编号。如果要在某个发送或接收的消息中使用这些字段，我们还要在字典文件 FIX42.xml 中加入这些字段。

5: DemoApplication_Test.cpp 文档包含所有能实现我们要测试的功能的函数。诸如单笔下单，组合下单等我们在文档中提及的功能。可以在这个文档的函数中更改交易的的证券代码，以及买卖方向等。

6: DemoApplication.cpp 文档的构造函数部分我们可以更改资金帐号，沪市股东帐号，深市股东帐号。

我们把要实现的功能都放在 OnLogon 回调函数中，用户可以在这里调用 DemoApplication_Test.cpp 中的函数进行测试。加密解密功能在函数 toAdmin 中实现。如果用户要实现 DES-ECB 加密，可以执行 UFX_DesEncode 函数，并将 FIX::EncryptMethod 参数设置为 2.

7: DemoApplication_OnMessage.cpp 文档描述我们如何接收某一类特定的消息。对于 FIX4.2 中原来没有的消息我们需要专门接收这些消息的回调函数 OnMessage。

8: 有一些字段如单笔委托应答的 6, 14 字段等我们的柜台是不返回的。但是为了满足 FIX 协议，应答中人为加入了这些字段，我们都将它们设置为零。客户在读取信息时应忽略这些字段。

9: windows visual studio 2013 使用:

在 source 文件夹中, 打开 Demo.sln 即可.

将 libsecurity 文件夹中跟 windows 版本相对应的加密解密文件 ufx_security.dll 复制到系统 system32 文件夹中(一般情况下是 C:\Windows\System32, windows8 的 64 位在 C:\Windows\SysWOW64)